

交银理财稳享固收精选日开 2 号（60 天持有期）理财产品定期报告（2022 年年度）

尊敬的客户：

我司交银理财稳享固收精选日开 2 号（60 天持有期）理财产品（理财信息登记系统产品登记编码：Z7000921000175）2022 年年度定期报告公告如下：

报告期为 2022 年 1 月 1 日至 2022 年 12 月 31 日。

一、期末资产组合情况

1.1 直接/间接投资资产分布。

投资资产分类	直接	间接	合计
现金	2.80%	2.97%	5.78%
债权类资产	17.14%	69.31%	86.44%
权益类资产	0.00%	7.78%	7.78%
商品及金融衍生品类	0.00%	0.00%	0.00%
合计	19.94%	80.06%	100.00%

1.2 穿透后前十大资产明细。

序号	资产名称	规模（万元）	占比
1	2020 年记账式付息(九期)国债	65,843.30	3.60%
2	活期存款	54,466.12	2.97%
3	活期存款	50,077.01	2.73%
4	1003 他行存款	48,505.39	2.65%
5	2022 年记账式付息(十四期)国债	45,310.33	2.47%
6	农行优 1	24,579.07	1.34%
7	1003 他行存款	23,392.10	1.28%
8	1003 他行存款	22,249.90	1.22%
9	泰康信用精选债券型证券投资基金	20,195.57	1.10%
10	1003 他行存款	19,308.28	1.05%
合计		373,927.07	20.42%

1.3 非标准化债权类资产明细。

报告期末，本产品不持有非标准化债权类资产。

二、报告期间关联交易发生情况

2.1 产品投资关联方发行、承销的证券的情况。

报告期内，本产品未投资于关联方发行、承销的证券。

2.2 产品投资关联方发行的资产管理产品情况。

序号	资产名称	累计发生金额(万元)	交易类型	关联方名称
1	交银国信·汇利 275 号集合资金信托计划	20,100.00	资产买入	交银国际信托有限公司
2	交银国信·汇利 275 号集合资金信托计划	20,112.34	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司
3	交银国信·汇利 125 号集合资金信托计划	17,000.00	资产买入	交银国际信托有限公司
4	交银国信·汇利 125 号集合资金信托计划	16,721.97	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司
5	交银国信汇利 200 号集合资金信托计划	178,000.00	资产买入	交银国际信托有限公司
6	交银国信汇利 200 号集合资金信托计划	1,257,914.50	资产卖出或到期	交银国际信托有限公司
7	交银施罗德资管卓远 1 号集合资管计划	15,300.00	资产买入	交银施罗德资产管理有限公司
8	交银施罗德资管卓远 1 号集合资管计划	15,357.21	资产卖出或到期	交银施罗德资产管理有限公司
9	交银施罗德资管卓远 2 号集合资产管理计划	22,200.00	资产买入	交银施罗德资产管理有限公司
10	交银施罗德资管卓远 2 号集合资产管理计划	64,471.32	资产卖出或到期	交银施罗德资产管理有限公司

2.3 产品向关联方支付的费用。

序号	费用类型	累计发生金额(万元)	关联方名称
1	托管费	635.44	交通银行股份有限公司

2	销售手续费	5,126.59	交通银行股份有限公司
---	-------	----------	------------

2.4 产品发生的其他关联交易。

报告期内，本产品未发生其他关联交易。

2.5 报告期末产品持有或通过资管产品持有的关联方发行、承销的证券。

序号	证券名称	持有金额（万元）	关联方名称
1	淮安市交通控股有限公司 2020 年度第一期定向债务融资工具	1,538.64	交通银行股份有限公司
2	郑州航空港兴港投资集团有限公司 2020 年度第三期定向债务融资工具	1,484.41	交通银行股份有限公司
3	岳阳市城市建设投资集团有限公司 2020 年度第一期定向债务融资工具	1,203.57	交通银行股份有限公司
4	青岛海洋投资集团有限公司 2020 年度第一期定向债务融资工具	1,493.57	交通银行股份有限公司
5	青岛城市建设投资(集团)有限责任公司 2020 年度第一期定向债务融资工具	595.82	交通银行股份有限公司
6	临沂投资发展集团有限公司 2021 年度第一期定向债务融资工具	606.62	交通银行股份有限公司
7	洛阳城乡建设投资集团有限公司 2021 年度第二期定向债务融资工具	15.96	交通银行股份有限公司
8	洛阳城乡建设投资集团有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	724.98	交通银行股份有限公司
9	中远海运租赁有限公司 2022 年度第一期定向债务融资工具	7.97	交通银行股份有限公司
10	杭州余杭创新投资有限公司 2022 年度第三期定向债务融资工具	572.33	交通银行股份有限公司
11	杭州余杭城市发展投资集团有限公司 2022 年度第六期定向债务融资工具	290.40	交通银行股份有限公司
12	天津城市基础设施建设投资集团有限公司 2022 年度第十期短期融资券	427.72	交通银行股份有限公司
13	深圳市前海融通商业保理有限公司 2021 年度第一期定向资产支持票据优先级	7,104.70	交通银行股份有限公司
14	中国三峡新能源(集团)股份有限公司 2021 年度第二期绿色资产支持票据(碳中和债)	407.93	交通银行股份有限公司
15	中国信达资产管理股份有限公司 2021 年无	587.29	交通银行股

	固定期限资本债券(第一期)		份有限公司
16	中国建设银行股份有限公司 2022 年二级资本债券(第二期)(品种二)	401.97	交通银行股份有限公司
17	无锡城市发展集团有限公司 2015 年度第一期中期票据(品种二)	449.01	交通银行股份有限公司
18	重庆市水利投资(集团)有限公司 2018 年度第一期中期票据	287.43	交通银行股份有限公司
19	武汉市水务集团有限公司 2019 年度第一期中期票据	146.89	交通银行股份有限公司
20	重庆市水利投资(集团)有限公司 2019 年度第一期中期票据	4.71	交通银行股份有限公司
21	陕西延长石油(集团)有限责任公司 2019 年度第十二期中期票据	1,270.15	交通银行股份有限公司
22	湖北省文化旅游投资集团有限公司 2020 年度第一期中期票据(疫情防控债)	1,707.92	交通银行股份有限公司
23	西安曲江文化产业投资(集团)有限公司 2020 年度第一期中期票据	689.41	交通银行股份有限公司
24	中交第二航务工程局有限公司 2020 年度第一期中期票据	2,812.73	交通银行股份有限公司
25	中交第四公路工程局有限公司 2020 年度第一期中期票据(品种二)	568.64	交通银行股份有限公司
26	重庆市涪陵国有资产投资经营集团有限公司 2021 年度第一期中期票据	1,018.84	交通银行股份有限公司
27	上海新世界(集团)有限公司 2021 年度第一期中期票据	8.10	交通银行股份有限公司
28	中航国际租赁有限公司 2021 年度第四期中期票据	3.21	交通银行股份有限公司
29	青岛西海岸新区融合控股集团有限公司 2021 年度第二期中期票据	899.82	交通银行股份有限公司
30	无锡市建设发展投资有限公司 2021 年度第四期中期票据	1,396.53	交通银行股份有限公司
31	北方凌云工业集团有限公司 2021 年度第一期中期票据	4.65	交通银行股份有限公司
32	中交第四公路工程局有限公司 2022 年度第一期中期票据(品种二)	601.26	交通银行股份有限公司
33	淄博市城市资产运营有限公司 2022 年度第四期中期票据	2,000.35	交通银行股份有限公司
34	平安国际融资租赁有限公司 2022 年度第一	719.34	交通银行股

	期中期票据		份有限公司
35	武汉金融控股(集团)有限公司 2022 年度第二 期中期票据	713.44	交通银行股 份有限公司
36	山东省港口集团有限公司 2022 年度第一期 中期票据	1,378.57	交通银行股 份有限公司
37	广西铁路投资集团有限公司 2022 年度第五 期中期票据	693.05	交通银行股 份有限公司
38	武汉市城市建设投资开发集团有限公司 2022 年度第一期中期票据	88.21	交通银行股 份有限公司
39	工元 2018 年第五期个人住房抵押贷款资产 支持证券优先 A-2 级资产支持证券	132.09	交通银行股 份有限公司
40	中国工商银行股份有限公司 2019 年无固定 期限资本债券	691.92	交通银行股 份有限公司
41	中国邮政储蓄银行股份有限公司 2020 年无 固定期限资本债券	509.65	交通银行股 份有限公司
42	中国银行股份有限公司 2020 年无固定期限 资本债券(第一期)	19.11	交通银行股 份有限公司
43	中国农业银行股份有限公司 2020 年无固定 期限资本债券(第一期)	323.62	交通银行股 份有限公司
44	2020 年中信银行股份有限公司二级资本债 券	307.57	交通银行股 份有限公司
45	中国银行股份有限公司 2020 年二级资本债 券(第一期)(品种一)	7,958.72	交通银行股 份有限公司
46	中国工商银行股份有限公司 2020 年二级资 本债券(第一期)	1,039.57	交通银行股 份有限公司
47	中国银行股份有限公司 2020 年无固定期限 资本债券(第二期)	749.26	交通银行股 份有限公司
48	中国工商银行股份有限公司 2020 年二级资 本债券(第二期)(品种一)	416.49	交通银行股 份有限公司
49	上海浦东发展银行股份有限公司 2020 年无 固定期限资本债券	199.87	交通银行股 份有限公司
50	恒丰银行股份有限公司 2020 年无固定期限 资本债券	14,505.92	交通银行股 份有限公司
51	中国工商银行股份有限公司 2021 年二级资 本债券(第一期)	280.62	交通银行股 份有限公司
52	中国银行股份有限公司 2021 年二级资本债 券(第一期)(品种一)	55.78	交通银行股 份有限公司
53	兴业银行股份有限公司 2021 年第二期二级	613.07	交通银行股

	资本债券(品种一)		份有限公司
54	浦鑫安居 2021 年第二期个人住房抵押贷款 优先 A-2 级资产支持证券	112.49	交通银行股 份有限公司
55	中国邮政储蓄银行股份有限公司 2022 年无 固定期限资本债券(第一期)	15.86	交通银行股 份有限公司

三、投资运作分析

3.1 基本情况。

产品名称	交银理财稳享固收精选日开 2 号（60 天持有期）理财产品			
报告期末产品 份额总额	15,619,859,373.31			
报告期末产品 资产净值 （万元）	1,624,820.70			
期末杠杆水平	112.71%			
下属产品份额 的销售名称	下属产品份 额的销售代 码	报告期末下属产品 份额的总份额	报告期末 下属产品 份额的单 位净值	报告期末下 属产品份额 的累计单位 净值
交银理财稳享 固收精选日开 2 号（60 天持有 期）理财产品	5811221046	13,935,271,020.19	1.0415	1.0415
交银理财稳享 固收精选日开 2 号私银尊享 （60 天持有 期）理财产品	5811221097	986,801,493.76	1.0316	1.0316
交银理财稳享 固收精选日开 2 号（60 天持有 期）理财产品 C	5811221104	697,786,859.36	1.0264	1.0264

报告期内最后一个市场交易日即 2022 年 12 月 30 日产品情况如下：

产品名称	交银理财稳享固收精选日开 2 号（60 天持有期）理财产品
最后一个交易	15,619,859,373.31

日产品份额总额				
最后一个交易日产品资产净值 (万元)	1,624,052.82			
下属产品份额的销售名称	下属产品份额的销售代码	最后一个交易日下属产品份额的总份额	最后一个交易日下属产品份额的单位净值	最后一个交易日下属产品份额的累计单位净值
交银理财稳享固收精选日开2号(60天持有期)理财产品	5811221046	13,935,271,020.19	1.0410	1.0410
交银理财稳享固收精选日开2号私银尊享(60天持有期)理财产品	5811221097	986,801,493.76	1.0312	1.0312
交银理财稳享固收精选日开2号(60天持有期)理财产品C	5811221104	697,786,859.36	1.0259	1.0259

以上产品资产净值、份额净值、累计净值均未扣除当期暂估的超额业绩报酬。

3.2 流动性风险分析。

本产品严格遵守监管流动性要求,并保持适度杠杆和久期操作,配置相应比例流动性较好的高等级债券,保证产品有充足的流动性应对客户赎回。

四、未来展望

2023年以来,国内宏观经济环境预期维持复苏状态,内需企稳,外需疲弱,房地产需求端的恢复有待时日,基本面逐渐复

苏的背景下，资金面预期维持宽松平衡，大幅收敛的概率不大，债券市场表现预期震荡，收益以票息收入为主。产品主要投资于债券等固定收益类资产，组合底层配置了一定比例的非波动性资产以期提升组合的夏普率与风险收益比，并根据宏观环境和货币政策面进行战术调整久期。产品后期的配置思路为严控信用风险，灵活调整久期，主要利用流动性溢价策略、骑乘策略与杠杆策略增厚组合收益。此外，我们建议客户在投资中，更加关注产品的长期表现，以期取得更好的投资回报。

五、托管人报告

5.1 报告期内本产品托管人遵规守信情况声明。

本报告期内，本产品托管人在对本产品的托管过程中，严格遵守法律法规和托管协议的有关规定，不存在损害理财产品份额持有人利益的行为，尽职尽责地履行了产品托管人应尽的义务。

5.2 托管人对报告期内本理财产品投资运作、净值计算、利润分配等情况的说明。

本报告期内，托管人未发现本产品的管理人——交银理财有限责任公司在本产品的投资运作、产品资产净值计算、产品份额申购赎回价格计算、产品费用开支等过程中存在损害产品份额持有人利益的行为。本报告期内，本产品未进行利润分配。

我司保留对以上所有文字说明的最终解释权。

感谢您一直以来对我司的支持！

特此公告。

交银理财有限责任公司

2023 年 4 月 17 日